

# 前海开源现金增利货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	债券回购融资情况	39
7.3	基金投资组合平均剩余期限	39
7.4	报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6	期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	40
7.7	“影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	41
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	41
7.9	投资组合报告附注	41
§ 8	基金份额持有人信息	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42

8.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	42
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	43
§ 9	开放式基金份额变动 .....	43
§ 10	重大事件揭示 .....	44
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	44
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4	基金投资策略的改变 .....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	46
10.9	其他重大事件 .....	46
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
§ 12	备查文件目录 .....	48
12.1	备查文件目录 .....	49
12.2	存放地点 .....	49
12.3	查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源现金增利货币市场基金		
基金简称	前海开源货币		
基金主代码	001870		
基金运作方式	契约型普通开放式		
基金合同生效日	2015年09月29日		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,197,070,143.04份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
下属分级基金的交易代码	001870	001871	004210
报告期末下属分级基金的份额总额	60,980,458.45份	4,941,450,559.58份	194,639,125.01份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	<p>本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、短期资金市场状况等因素的分析，综合判断未来短期利率变动，评估各类投资品种的流动性和风险收益特征，确定各类投资品种的配置比例及期限组合，并适时进行动态调整。</p> <p>2、利率预期策略</p> <p>通过对通货膨胀、GDP、货币供应量、国际利率水平、金融监管政策取向等跟踪分析，形成对基本面的宏观研判。同时，结合微观层面研究，主要考察指标包括：央行公开市场操作、主要机构投资者的短期投资倾向、债券供给、回购抵押数量等，合理预期货币市场利率曲线动态变化，动态配置货币资产。</p> <p>3、期限配置策略</p> <p>根据利率预期分析，动态确定并控制投资组合平均剩余期限在120天以内。当市场利率看涨时，适度缩短投资组合平均剩余期限，即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种，降低组合整体净值损失风险；当市场看跌时，则相对延长投资组合平均剩余期限，增持较长剩余期限的投资品种，获取超额收益。</p>

	<p>4、流动性管理策略</p> <p>本基金作为现金管理工具，必须具备较高的流动性。基金管理人在密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素基础上，对投资组合的现金比例进行优化管理。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，以满足日常的基金资产变现需求。</p> <p>5、收益增强策略</p> <p>通过分析各类投资品种的相对收益、利差变化、市场容量、信用等级情况、流动性风险、信用风险等因素来确定配置比例和期限组合，寻找具有投资价值的投资品种，增持相对低估、价格将上升的，能给组合带来相对较高回报的类属；减持相对高估、价格将下降的，给组合带来相对较低回报的类属，借以取得较高的总回报。</p>
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	方圆
	联系电话	0755-88601888	95559
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4001-666-998	95559
传真		0755-83181169	021-62701216
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		518040	200336
法定代表人		李强	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024年01月01日至2024年06月30日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
本期已实现收益	481,724.29	72,868,901.10	959,598.97
本期利润	481,724.29	72,868,901.10	959,598.97
本期净值收益率	0.8355%	0.9561%	0.8360%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024年06月30日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
期末基金资产净值	60,980,458.45	4,941,450,559.58	194,639,125.01
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024年06月30日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
累计净值收益率	22.4181%	25.0201%	18.8505%

注：① 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

② 本基金的利润分配方式是“每日分配、按日支付”。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1255%	0.0034%	0.1125%	0.0000%	0.0130%	0.0034%
过去三个月	0.3875%	0.0030%	0.3413%	0.0000%	0.0462%	0.0030%
过去六个月	0.8355%	0.0030%	0.6825%	0.0000%	0.1530%	0.0030%
过去一年	1.7529%	0.0034%	1.3725%	0.0000%	0.3804%	0.0034%
过去三年	5.3426%	0.0028%	4.1100%	0.0000%	1.2326%	0.0028%
自基金合同生效起至今	22.4181%	0.0031%	11.9925%	0.0000%	10.4256%	0.0031%

前海开源货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1451%	0.0034%	0.1125%	0.0000%	0.0326%	0.0034%
过去三个月	0.4475%	0.0030%	0.3413%	0.0000%	0.1062%	0.0030%

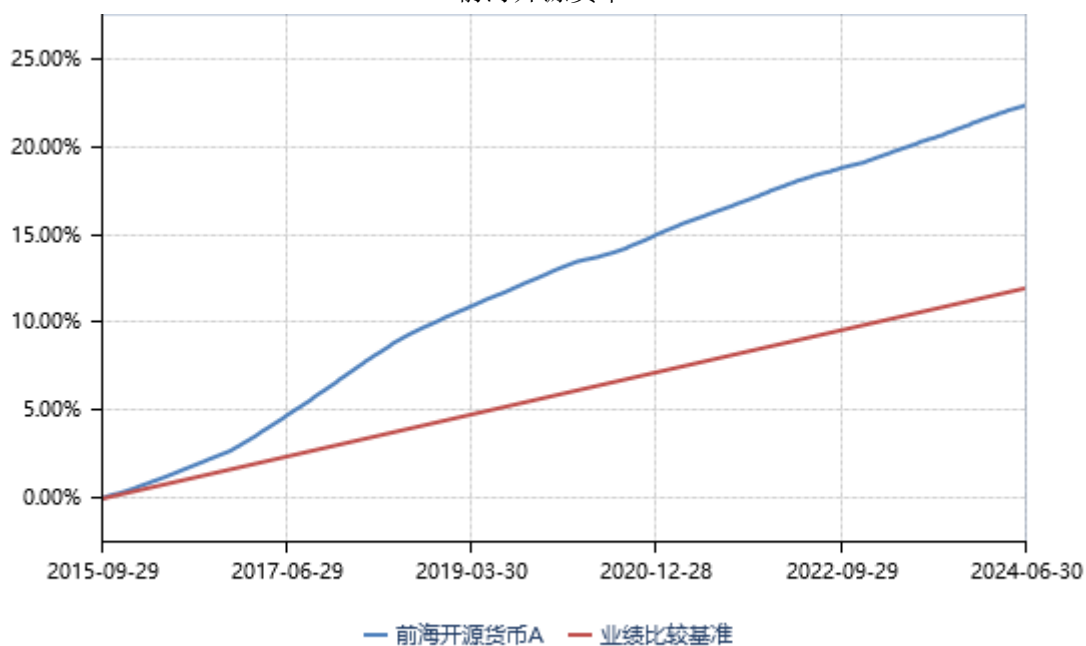
过去六个月	0.9561%	0.0030%	0.6825%	0.0000%	0.2736%	0.0030%
过去一年	1.9980%	0.0034%	1.3725%	0.0000%	0.6255%	0.0034%
过去三年	6.1043%	0.0028%	4.1100%	0.0000%	1.9943%	0.0028%
自基金合同生效起至今	25.0201%	0.0031%	11.9925%	0.0000%	13.0276%	0.0031%

前海开源货币 E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1253%	0.0033%	0.1125%	0.0000%	0.0128%	0.0033%
过去三个月	0.3881%	0.0030%	0.3413%	0.0000%	0.0468%	0.0030%
过去六个月	0.8360%	0.0030%	0.6825%	0.0000%	0.1535%	0.0030%
过去一年	1.7518%	0.0034%	1.3725%	0.0000%	0.3793%	0.0034%
过去三年	5.3393%	0.0028%	4.1100%	0.0000%	1.2293%	0.0028%
自基金合同生效起至今	18.8505%	0.0032%	10.2113%	0.0000%	8.6392%	0.0032%

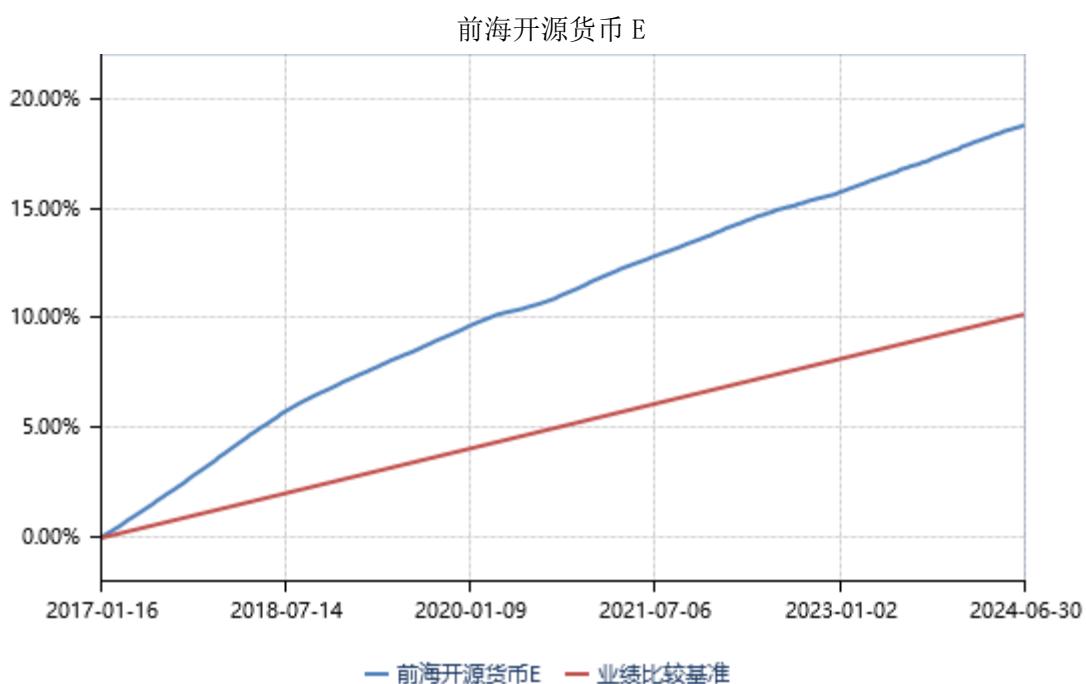
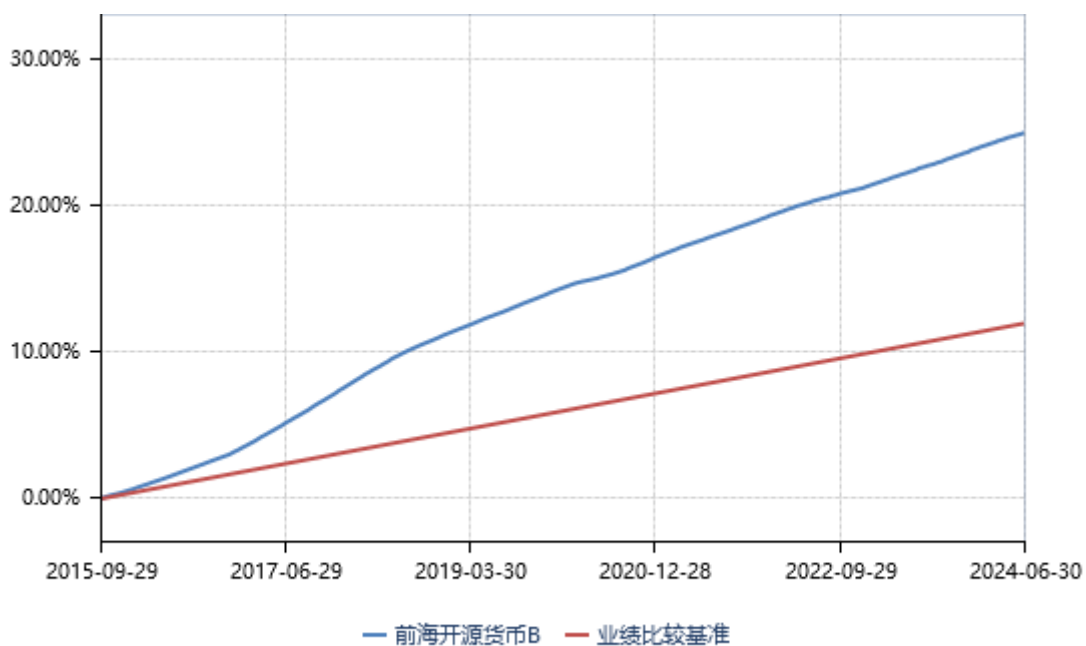
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

前海开源货币 A



前海开源货币 B





注：本基金自 2017 年 1 月 13 日起，增加 E 类基金份额并设置对应基金代码；2017 年 1 月 13 日、2017 年 1 月 14 日、2017 年 1 月 15 日 E 类基金份额为零。前海开源货币 E 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较起始日为 2017 年 1 月 16 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投资合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司已于2013年9月5日在深圳市注册成立，并于2013年9月18日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为1.8亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理96只开放式基金，资产管理规模超过949亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘静	本基金的基金经 理、公司董事总经 理	2015年09 月29日	-	22年	刘静女士，中央财经大学硕士。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理；2014年1月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司董事总经理、基金经理。
林悦	本基金的基金经理	2019年07 月29日	-	10年	林悦先生，厦门大学硕士。2014年至2016年任汇添富基金管理股份有限公司投资研究总部债券交易员；2016年9月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理。
张艳琳	本基金的基金经理	2021年03	-	9年	张艳琳女士，上海财

	助理	月 16 日			经大学硕士研究生。2015 年 7 月至 2015 年 12 月任上海红御投资管理有限公司融资助理；2016 年 1 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理助理。
--	----	--------	--	--	--

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，经济增长预期、流动性、机构行为、风险偏好是影响债市走势的关键因素。具体

来看：

1-2月，由于融资增速延续下行，且风险资产弱势，债市整体较为强势。进入3月，随着经济数据回暖，债市由单边下行转为震荡，波动明显加大。进入2季度，除经济基本面这个主导债市的关键因素外，机构行为、流动性对债券类资产的趋势和结构的影响明显上升。4月初，由于跨季后资金较为宽松，中短久期利率债表现明显强于长端利率债，各类利差压缩至低位。4月下旬，债市出现了较大幅度的调整，信用债调整幅度明显大于利率债。之后随着市场修复，负反馈担忧解除，加上配置需求仍然强劲，信用债重新走强。5月后，尽管地产政策持续出台，但在基本面数据偏弱、流动性宽松、机构配置需求较强的共同作用下，债市延续强势，信用利差收窄至历史低位。整个上半年来看，2季度后利率债期限利差明显走阔；因配置需求强劲，信用债表现明显强于利率债。

资金面来看，资金以春节为分界线，先紧后松。春节前资金面延续了去年10月以来紧平衡的态势，分层压力偏高，春节后，在资金快速回笼以及财政加速投放的影响下，资金分层较之前明显缓解，资金价格快速下行，大部分时间DR007在1.7%-2.0%之间波动。二季度资金面的扰动的主线是“禁止手工补息”，资金持续从银行负债端向非银负债端流动，造成了4月底银行负债端压力的突然上升以及5-6月的非银的“资产荒”。R007-DR007的利差和信用资产的利差进一步压缩。

整个半年度来看，10年期、30年期利率债收益率先震荡下行，后在区间内震荡。波动区间分别为2.21%-2.56%、2.42%-2.84%。1年期以内资产普遍震荡下行，1年期国债、3个月存单、1年期存单整个上半年分别下行54bp、5bp、45bp。

操作上，本基金1月初认为资金分层压力依然较大，资金面整体或依旧呈现量足价高的态势，组合配置以回购和不跨季的短融和存单为主。2月上旬组合开始对资金面转为中性偏乐观，组合平均剩余期限保持在中性水平，4月下旬，也适度降低了组合久期。组合配置整体以回购和不跨季的短融和刚跨季的存单为主，以提高组合的静态收益。整个报告期内，组合平均剩余期限保持在中性略低的水平。组合在严格控制信用风险的同时保持了充足的流动性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.8355%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%；截至报告期末前海开源货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9561%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%；截至报告期末前海开源货币E基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.8360%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，因经济在向新的增长模式转变的过程中对融资的依赖逐步下降，债券收益率有望继续下行。但因目前绝对点位已较低，债券收益率下行的速度大概率放缓，且随着绝对点位降低，债市波动可能加大。尽管长期来看债券收益率趋于下行，中期内社融增速仍是影响债市走势的关键因素。考虑到金融挤水分仍在继续，但随着时间推移，金融挤水分对社融增速的影响可能会趋于弱化，社融增速可能会在3季度见底。整个上半年地方债发行速度偏慢，后续预计会有所提速，资金面可能会边际收敛，届时还是要观察央行的操作和存单一级提价需求再操作。组合将继续重视票息收益，以中短久期的高评级同业存单为主，并适时调整组合杠杆，在控制流动性风险的前提下力争提高组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员包含投资、研究、会计和风控等岗位资深人员，均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经验。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》，本基金每日将各级基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在前海开源现金增利货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，前海开源基金管理有限公司在前海开源现金增利货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由前海开源基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关前海开源现金增利货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：前海开源现金增利货币市场基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	104,267,142.94	1,103,165,922.92
结算备付金		-	-
存出保证金		22,688.27	17,290.06
交易性金融资产	6.4.7.2	2,967,848,538.14	3,637,383,172.41
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,967,848,538.14	3,635,382,764.74
资产支持证券投资		-	2,000,407.67
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,518,758,457.78	1,735,319,024.39
应收清算款		15,168,120.32	-
应收股利		-	-

应收申购款		790,529,260.11	418,817,431.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		5,396,594,207.56	6,894,702,841.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		105,021,575.35	216,112,244.58
应付清算款		91,743,663.61	20,097,706.83
应付赎回款		242,779.23	2.14
应付管理人报酬		1,243,372.99	1,207,158.87
应付托管费		348,144.46	338,004.47
应付销售服务费		102,768.92	66,627.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		33,783.32	17,361.47
应付利润		190,615.72	400,095.34
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	597,360.92	597,357.32
负债合计		199,524,064.52	238,836,558.67
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	5,197,070,143.04	6,655,866,282.95
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		5,197,070,143.04	6,655,866,282.95
负债和净资产总计		5,396,594,207.56	6,894,702,841.62

注：报告截止日2024年06月30日，前海开源货币基金份额总额5,197,070,143.04份，其中，前海开源货币A类基金份额净值1.0000元，基金份额总额60,980,458.45份；前海开源货币B类基金份额净值1.0000元，基金份额总额4,941,450,559.58份；前海开源货币E类基金份额净值1.0000元，基金份额总额194,639,125.01份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源现金增利货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01 日至2024年06 月30日	上年度可比期间 2023年01月01 日至2023年06 月30日
一、营业总收入		89,197,674.49	112,975,100.03

1. 利息收入		39,840,227.10	54,617,891.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,023,728.47	16,681,533.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,816,498.63	37,936,358.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,357,447.39	58,357,208.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	49,281,100.51	58,154,901.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	76,346.88	202,306.78
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		14,887,450.13	17,237,913.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,037,633.97	12,123,673.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,810,537.55	3,394,628.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	614,451.96	582,924.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,237,839.20	941,312.22
其中：卖出回购金融资产支出		1,237,839.20	941,312.22
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		13,570.15	31,110.25
8. 其他费用	6.4.7.20	173,417.30	164,263.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		74,310,224.36	95,737,186.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		74,310,224.36	95,737,186.69
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		74,310,224.36	95,737,186.69

### 6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源现金增利货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计



一、上期期末净资产	6,655,866,282.95	-	6,655,866,282.95
二、本期期初净资产	6,655,866,282.95	-	6,655,866,282.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,458,796,139.91	-	-1,458,796,139.91
（一）、综合收益总额	-	74,310,224.36	74,310,224.36
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,458,796,139.91	-	-1,458,796,139.91
其中：1. 基金申购款	54,490,947,299.02	-	54,490,947,299.02
2. 基金赎回款	-	-	-
	55,949,743,438.93		55,949,743,438.93
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-74,310,224.36	-74,310,224.36
四、本期期末净资产	5,197,070,143.04	-	5,197,070,143.04
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,443,224,265.58	-	7,443,224,265.58
二、本期期初净资产	7,443,224,265.58	-	7,443,224,265.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	844,101,632.13	-	844,101,632.13
（一）、综合收益总额	-	95,737,186.69	95,737,186.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	844,101,632.13	-	844,101,632.13
其中：1. 基金申购款	49,241,571,612.03	-	49,241,571,612.03
2. 基金赎回款	-	-	-
	48,397,469,979.90		48,397,469,979.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-95,737,186.69	-95,737,186.69
四、本期期末净资产	8,287,325,897.71	-	8,287,325,897.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰

王厚琼

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源现金增利货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中

国证监会”)证监许可[2015]2080号《关于准予前海开源现金增利货币市场基金注册的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,076,267,084.22元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]02230059号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》于2015年9月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,076,277,239.93份,其中认购资金利息折合10,155.71份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》,本基金根据投资人单笔认购/申购本基金的金额、单个账户中持有本基金份额的数量或投资人申购本基金的其他不同条件,分别设置A类基金份额和B类基金份额。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别,并根据其持有的基金份额数额成为某一类别的基金份额持有人,不同基金份额类别之间不得互相转换,但依据基金合同或招募说明书约定因认购、申购、赎回、基金转换等交易及收益结转份额而发生基金份额自动升级或者降级的除外。根据《关于前海开源现金增利货币市场基金增加E类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》和更新后的《前海开源现金增利货币市场基金招募说明书》,自2017年1月13日起本基金增加E类基金份额。E类基金份额与A类基金份额适用相同的管理费率、托管费率和销售服务费率,其单笔申购申请最低限额为人民币0.01元,单笔赎回申请最低限额为0.01份。E类基金份额不进行基金份额升降级。投资者需通过本基金的基金管理人指定的销售平台办理E类基金份额的申购、赎回等业务。各类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证

券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

无。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产

品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	3,995,142.78
等于：本金	3,994,198.66
加：应计利息	944.12
定期存款	100,272,000.16
等于：本金	100,000,000.00
加：应计利息	272,000.16
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	100,272,000.16
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	104,267,142.94

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日

		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	30,317,795.86	30,321,920.55	4,124.69	0.0001
	银行间市场	2,937,530,742.28	2,937,890,542.18	359,799.90	0.0069
	合计	2,967,848,538.14	2,968,212,462.73	363,924.59	0.0070
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,967,848,538.14	2,968,212,462.73	363,924.59	0.0070

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,518,758,457.78	-
合计	1,518,758,457.78	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	334,097.70
其中：交易所市场	-
银行间市场	334,097.70
应付利息	-
预提费用	263,263.22

合计	597,360.92
----	------------

#### 6.4.7.7 实收基金

前海开源货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,506,250.20	60,506,250.20
本期申购	394,349,972.51	394,349,972.51
本期赎回（以“-”号填列）	-393,875,764.26	-393,875,764.26
本期末	60,980,458.45	60,980,458.45

前海开源货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,532,532,569.72	6,532,532,569.72
本期申购	53,520,105,532.07	53,520,105,532.07
本期赎回（以“-”号填列）	-55,111,187,542.21	-55,111,187,542.21
本期末	4,941,450,559.58	4,941,450,559.58

前海开源货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,827,463.03	62,827,463.03
本期申购	576,491,794.44	576,491,794.44
本期赎回（以“-”号填列）	-444,680,132.46	-444,680,132.46
本期末	194,639,125.01	194,639,125.01

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

前海开源货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	481,724.29	-	481,724.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-481,724.29	-	-481,724.29
本期末	-	-	-

前海开源货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	72,868,901.10	-	72,868,901.10
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-72,868,901.10	-	-72,868,901.10
本期末	-	-	-

前海开源货币 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	959,598.97	-	959,598.97
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-959,598.97	-	-959,598.97
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	32,064.88
定期存款利息收入	9,991,516.86
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	146.73
合计	10,023,728.47

#### 6.4.7.10 股票投资收益--买卖股票差价收入

无。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益--利息收入	38,051,559.16
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	11,229,541.35
债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	49,281,100.51

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,066,709,912.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,925,876,228.76
减：应计利息总额	129,584,342.79
减：交易费用	19,800.00
买卖债券差价收入	11,229,541.35

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06 月30日
资产支持证券投资收益--利息收入	76,346.88
资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益--赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益--申购差价收入	-
合计	76,346.88

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	73,497,020.63
减：卖出资产支持证券成本总额	72,000,000.00
减：应计利息总额	1,497,020.63



减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益--其他投资收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

无。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

#### 6.4.7.18 其他收入

无。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	74,590.88
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	20,159.08
账户维护费	18,000.00

其他	995.00
合计	173,417.30

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金销售机构、基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至 2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,037,633.97	12,123,673.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,955,132.95	1,396,866.88
应支付基金管理人的净管理费	8,082,501.02	10,726,806.71

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年 06月30日	2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,810,537.55	3,394,628.55

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.07%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.07%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	前海开源货币 A	前海开源货 币B	前海开源 货币E	合计
前海开源基金	18,868.91	128,340.02	599.44	147,808.37
交通银行	4,209.40	4,665.29	-	8,874.69
开源证券	701.86	21.84	-	723.70
合计	23,780.17	133,027.15	599.44	157,406.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			

	前海开源货币 A	前海开源货 币 B	前海开源 货币 E	合计
前海开源基金	9,171.45	296,806.44	650.04	306,627.93
交通银行	3,490.69	1,348.49	-	4,839.18
开源证券	305.33	274.00	-	579.33
合计	12,967.47	298,428.93	650.04	312,046.44

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。前海开源货币 A 类基金份额、前海开源货币 B 类基金份额和前海开源货币 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01% 和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日对应类别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	99,882,016.67	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	49,802,891.30	40,755,324.38	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

前海开源货币 B

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
基金合同生效日（2015年09月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	40,179,671.84	98,796,455.23
报告期间申购/买入总份额	461,860,953.98	120,695,495.62
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	359,273,001.55	219,491,950.85
报告期末持有的基金份额	142,767,624.27	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.89%	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、基金转换入和强制调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出和强制调减份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

前海开源货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2024年06月30日		2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)	11,505,250.45	0.23%	11,396,032.31	0.17%
前海开源资产管理有限公司	93,204,761.30	1.89%	-	-

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,995,142.78	32,064.88	6,687,224.24	36,470.18

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金因投资本基金托管人交通银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 562,245.39 元(2023 年上半年度：66,664.26 元)。于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交通银行的同业存单(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.11 利润分配情况

前海开源货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
483,114.55	-	-1,390.26	481,724.29	-

前海开源货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
73,079,544.61	-	-210,643.51	72,868,901.10	-

前海开源货币 E

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
957,044.82	-	2,554.15	959,598.97	-

#### 6.4.12 期末 2024 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额 105,021,575.35 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220322	22 进出 22	2024 年 07 月 01 日	102.02	620,000	63,249,753.51
230211	23 国开 11	2024 年 07 月 01 日	101.56	500,000	50,779,748.33
合计				1,120,000	114,029,501.84

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他国内大中型商业银行处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总，参见附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	503,921,052.78	514,361,935.76
合计	503,921,052.78	514,361,935.76

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,300,214,828.58	2,915,514,228.83



合计	2,300,214,828.58	2,915,514,228.83
----	------------------	------------------

注：同业存单信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	20,594,353.80	61,781,300.18
AAA以下	-	-
未评级	143,118,302.98	143,725,299.97
合计	163,712,656.78	205,506,600.15

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	2,000,407.67
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	2,000,407.67

注：资产支持证券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的

20%。

本报告期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	104,267,142.94	-	-	-	104,267,142.94
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	22,688.27	-	-	-	22,688.27
交易性金融资产	2,967,848,538.14	-	-	-	2,967,848,538.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,518,758,457.78	-	-	-	1,518,758,457.78
应收清算款	-	-	-	15,168,120.32	15,168,120.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	790,529,260.11	790,529,260.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,590,896,827.13	-	-	805,697,380.43	5,396,594,207.56
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	105,021,575.35	-	-	-	105,021,575.35
应付清算款	-	-	-	91,743,663.61	91,743,663.61
应付赎回款	-	-	-	242,779.23	242,779.23
应付管理人报酬	-	-	-	1,243,372.99	1,243,372.99
应付托管费	-	-	-	348,144.46	348,144.46
应付销售服务费	-	-	-	102,768.92	102,768.92
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	33,783.32	33,783.32
应付利润	-	-	-	190,615.72	190,615.72
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	597,360.92	597,360.92
负债总计	105,021,575.35	-	-	94,502,489.17	199,524,064.52
利率敏感度缺口	4,485,875,251.78	-	-	-711,194,891.26	5,197,070,143.04
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,103,165,922.92	-	-	-	1,103,165,922.92
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	17,290.06	-	-	-	17,290.06
交易性金融资产	3,637,383,172.41	-	-	-	3,637,383,172.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,735,319,024.39	-	-	-	1,735,319,024.39
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	418,817,431.84	418,817,431.84
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,475,885,409.78	-	-	418,817,431.84	6,894,702,841.62
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	216,112,244.58	-	-	-	216,112,244.58
应付清算款	-	-	-	20,097,706.83	20,097,706.83
应付赎回款	-	-	-	2.14	2.14
应付管理人报酬	-	-	-	1,207,158.87	1,207,158.87
应付托管费	-	-	-	338,004.47	338,004.47
应付销售服务费	-	-	-	66,627.65	66,627.65
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	17,361.47	17,361.47
应付利润	-	-	-	400,095.34	400,095.34
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	597,357.32	597,357.32
负债总计	216,112,244.58	-	-	22,724,314.09	238,836,558.67
利率敏感度缺口	6,259,773,165.20	-	-	-396,093,117.75	6,655,866,282.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降25个基点	1,647,994.92	1,819,838.06
市场利率上升25个基点	-1,645,815.89	-1,817,739.51	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,967,848,538.14	3,637,383,172.41
第三层次	-	-
合计	2,967,848,538.14	3,637,383,172.41

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

### §7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,967,848,538.14	54.99
	其中：债券	2,967,848,538.14	54.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,518,758,457.78	28.14
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

3	银行存款和结算备付金合计	104,267,142.94	1.93
4	其他各项资产	805,720,068.70	14.93
5	合计	5,396,594,207.56	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.91	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	105,021,575.35	2.02
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

无。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	36.91	3.79
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	9.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	30.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90天(含)—120天	1.91	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	9.62	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		88.63	3.79

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的 账面价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,317,795.86	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	254,900,197.59	4.90
	其中: 政策性金融债	254,900,197.59	4.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	361,821,362.31	6.96
6	中期票据	20,594,353.80	0.40
7	同业存单	2,300,214,828.58	44.26
8	其他	-	-
9	合计	2,967,848,538.14	57.11
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账 面价值	占基金资产净值 比例(%)
1	112415164	24 民生银行 CD164	2,000,000	199,758,813.95	3.84
2	112410169	24 兴业银行 CD169	2,000,000	199,240,988.46	3.83
3	112304044	23 中国银行 CD044	2,000,000	199,218,164.87	3.83
4	112481414	24 宁波银行 CD075	2,000,000	199,062,590.48	3.83
5	112302053	23 工商银行 CD053	2,000,000	198,694,323.12	3.82



6	112305211	23 建设银行 CD211	1,000,000	99,708,123.85	1.92
7	112495070	24 宁波银行 CD012	1,000,000	99,598,259.12	1.92
8	112409171	24 浦发银行 CD171	1,000,000	99,570,456.92	1.92
9	112303207	23 农业银行 CD207	1,000,000	99,569,943.15	1.92
10	112303209	23 农业银行 CD209	1,000,000	99,566,079.96	1.92

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0842%
报告期内偏离度的最低值	0.0070%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0260%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

#### 7.9.2 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	22,688.27
2	应收清算款	15,168,120.32
3	应收利息	-
4	应收申购款	790,529,260.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	805,720,068.70

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源货币 A	13,041	4,676.06	37,418,930.08	61.36%	23,561,528.37	38.64%
前海开源货币 B	104	47,513,947.69	4,926,443,186.23	99.70%	15,007,373.35	0.30%
前海开源货币 E	34,225	5,687.05	99,224,438.49	50.98%	95,414,686.52	49.02%
合计	47,370	109,712.27	5,063,086,554.80	97.42%	133,983,588.24	2.58%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

#### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	500,000,000.00	9.62%
2	银行类机构	400,049,116.91	7.70%
3	其他机构	300,079,155.21	5.77%
4	保险类机构	297,692,020.37	5.73%

5	银行类机构	154,908,338.21	2.98%
6	券商类机构	150,012,040.23	2.89%
7	基金类机构	142,755,928.83	2.75%
8	基金类机构	121,179,726.10	2.33%
9	银行类机构	100,120,532.81	1.93%
10	基金类机构	100,064,838.81	1.93%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源货币 A	2,554,499.22	4.1890%
	前海开源货币 B	0.00	0.0000%
	前海开源货币 E	31,466.59	0.0162%
	合计	2,585,965.81	0.0498%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海开源货币 A	10~50
	前海开源货币 B	0
	前海开源货币 E	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源货币 A	0~10
	前海开源货币 B	0
	前海开源货币 E	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
基金合同生效日（2015年09月29日）基金份额总额	34,070,939.93	2,042,206,300.00	-
本报告期期初基金份额总额	60,506,250.20	6,532,532,569.72	62,827,463.03
本报告期基金总申购份额	394,349,972.51	53,520,105,532.07	576,491,794.44

减：本报告期基金总赎回份额	393,875,764.26	55,111,187,542.21	444,680,132.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,980,458.45	4,941,450,559.58	194,639,125.01

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人的重大人事变动：2024年4月23日起，王厚琼先生任副总经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	2	-	-	-	-	-

财通证券	2	-	-	-	-	-
长城国瑞 证券	2	-	-	-	-	本报告期 退租 1 个
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	本报告期 新增 2 个
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	本报告期 新增 2 个
海通证券	2	-	-	-	-	本报告期 新增 2 个
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和相关业务规则，本基金管理人制定了基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序，其中，除被动股票型基金以外的其他类型基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序如下：

A：选择标准

1. 分类评价结果；2. 研究所人数及成立时间；3. 研究所行业覆盖度；4. 近 1 年研究及经纪业务未受到重大行政处罚，或受到重大行政处罚时间已满 1 年并且完成整改；5. 其他可增强资质的情况及特色。

B：选择程序

证券公司的选择由本基金管理人交易单元管理小组决定。管理小组根据选择标准来挑选财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并根据证券公司提供研究服务的情况对各往来证券公司进行评估，评估结果作为交易单元租用选择和调整的参考依据。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城国瑞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	428,261,363.01	100.00%	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

#### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2024年01月05日
2	关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年01月10日
3	前海开源现金增利货币市场基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年01月22日
4	关于前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2024年02月07日
5	关于旗下部分基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
6	关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月06日
7	前海开源基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月18日
8	关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月29日
9	前海开源现金增利货币市场基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024年03月30日
10	前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2024年04月02日
11	前海开源现金增利货币市场基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年04月22日
12	前海开源基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024年04月24日
13	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2024年05月15日
14	关于旗下部分基金增加上海证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年05月23日
15	关于前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2024年06月06日
16	前海开源现金增利货币市场基金基金产品资料概要更新（20240626 更新）	中国证监会规定媒介	2024年06月26日
17	关于前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入	中国证监会规定媒介	2024年06月27日

	业务限制的公告		
--	---------	--	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240103- 20240104	-	2,001,151,246 .68	2,001,151,246 .68	-	-
	2	20240229- 20240229	819,665,035. 59	4,879,448.33	824,544,483.9 2	-	-
	3	20240326- 20240402, 202404 29- 20240507, 202405 30-20240603	-	8,004,157,591 .90	8,004,157,591 .90	-	-
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录



## 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源现金增利货币市场基金设立的文件
- (2) 《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》
- (3) 《前海开源现金增利货币市场基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源现金增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司  
2024年08月30日